

附表1 銀行衍生性金融商品交易量彙總表

商 品 種 類 別

104年7月

單位：新臺幣百萬元；%

商 品 種 類	本國銀行及外國銀行在台分行 ¹			
	涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計	比 重
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	152,080	460,241	612,321	3.76
(一)店頭市場(OTC)	152,080	124,936	277,016	1.70
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	335,305	335,305	2.06
二、匯率有關契約²(Foreign Exchange Transactions)	5,401,004	9,859,738	15,260,742	93.68
(一)店頭市場(OTC)	5,401,004	9,753,408	15,154,412	93.03
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	-	106,330	106,330	0.65
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	365,047	5,676	370,723	2.28
(一)店頭市場(OTC)	238	1,597	1,835	0.01
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	364,809	4,079	368,888	2.27
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	849	43,147	43,996	0.27
(一)店頭市場(OTC)	-	20,005	20,005	0.12
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	849	23,142	23,991	0.15
小 計(一至四)	5,918,980	10,368,802	16,287,782	99.99
五、信用有關契約(Credit Contracts)	-	1,822	1,822	0.01
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-
總 計	5,918,980	10,370,624	16,289,604	100.00

註：1. 包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

2. 匯率有關契約中「涉及新臺幣交易」金額包括新臺幣對外幣無本金交割遠期外匯交易；「純外幣交易」金額包括外幣保證金交易以遠期契約承作者。

交 易 幣 別 比 較

單位：新臺幣百萬元；%

交 易 幣 別		涉及新臺幣交易	純外幣交易	合 計
104年7月	金 額	5,918,980	10,370,624	16,289,604
	比 重	36.34	63.66	100.00
104年6月	金 額	4,976,488	9,431,689	14,408,177
	比 重	34.54	65.46	100.00
比較增減	差 額	942,492	938,935	1,881,427
	變動率	18.94	9.96	13.06

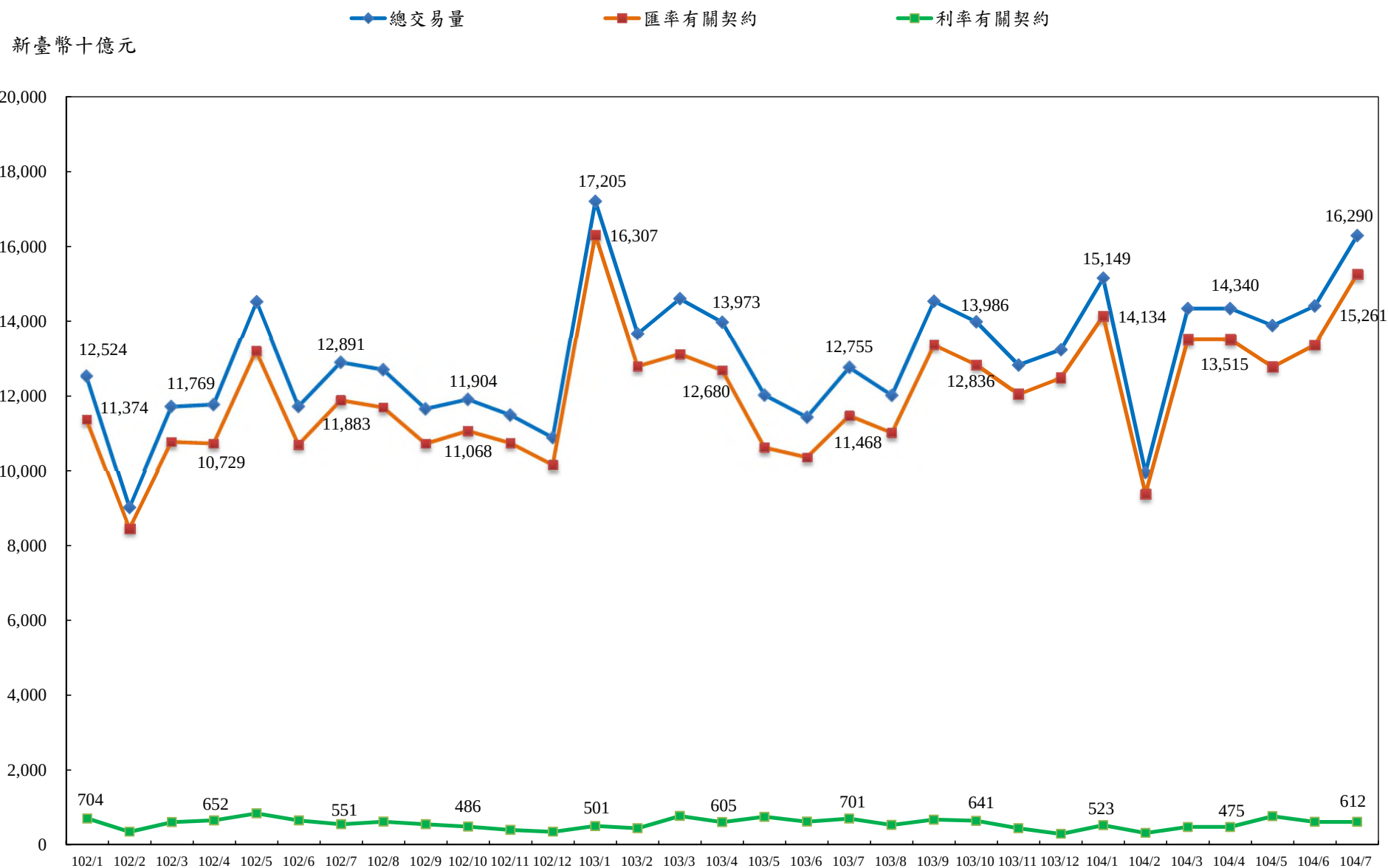
附表2 銀行衍生性金融商品交易量比較表

單位：新臺幣百萬元；%

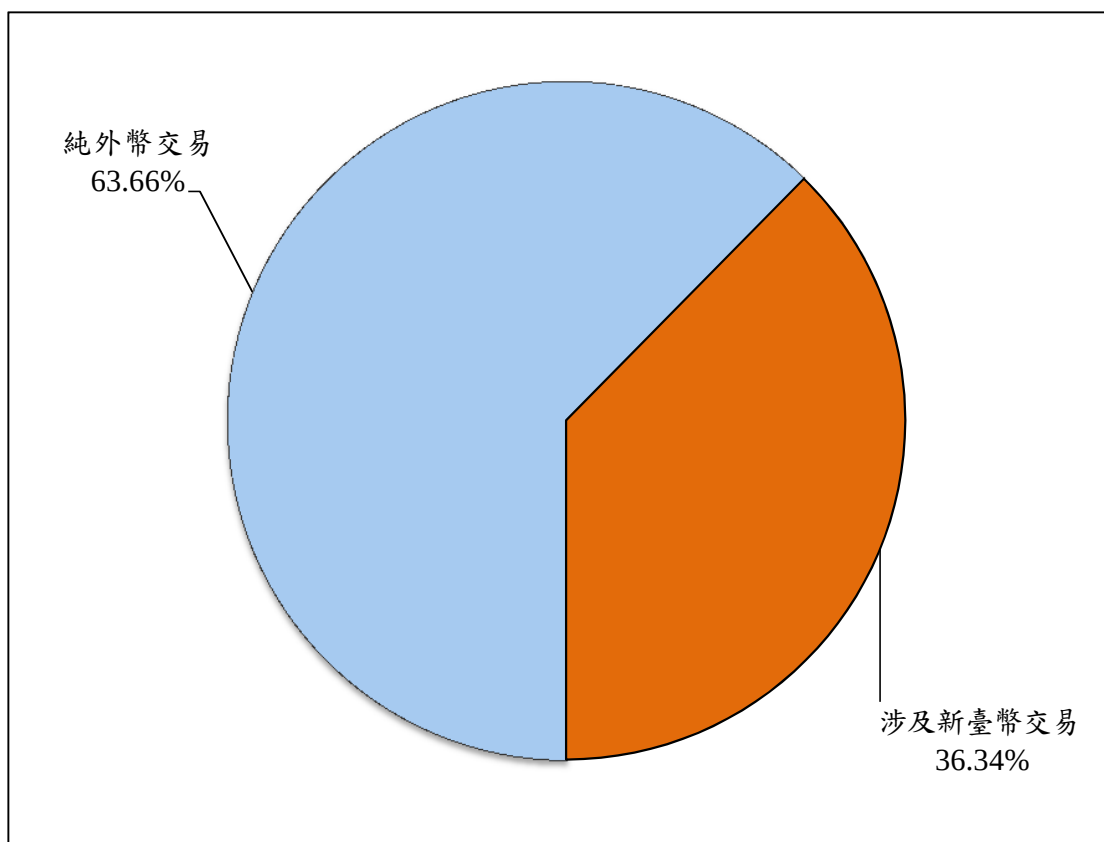
商 品 種 類	104年7月		104年6月		比較增減	
	合計	比重	合計	比重	差 額	變動率
一、利率有關契約(Interest Rate Contracts)	612,321	3.76	610,362	4.24	1,959	0.32
(一)店頭市場(OTC)	277,016	1.70	210,549	1.46	66,467	31.57
1.遠期利率協議(FRA)	-	-	-	-	-	-
2.換利(IRS)	264,716	1.62	203,769	1.41	60,947	29.91
3.買入選擇權(Bought Options)	1,033	0.01	1,307	0.01	-274	-20.96
4.賣出選擇權(Sold Options)	11,267	0.07	5,473	0.04	5,794	105.87
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	335,305	2.06	399,813	2.78	-64,508	-16.13
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	163,036	1.00	199,215	1.39	-36,179	-18.16
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	168,741	1.04	200,598	1.39	-31,857	-15.88
3.買入選擇權(Bought Options)	1,468	0.01	-	-	1,468	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	2,060	0.01	-	-	2,060	-
二、匯率有關契約(Foreign Exchange Transactions)	15,260,742	93.68	13,369,029	92.79	1,891,713	14.15
(一)店頭市場(OTC)	15,154,412	93.03	13,369,029	92.79	1,785,383	13.35
1.遠期契約(Outright Forwards)	1,471,737	9.04	1,206,320	8.37	265,417	22.00
2.換匯(Fx Swaps)	9,615,824	59.03	8,651,227	60.04	964,597	11.15
3.換匯換利(Currency Swaps)	99,852	0.61	68,555	0.48	31,297	45.65
4.買入選擇權(Bought Options)	2,031,958	12.47	1,765,916	12.26	266,042	15.07
5.賣出選擇權(Sold Options)	1,935,041	11.88	1,677,011	11.64	258,030	15.39
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	106,330	0.65	-	-	106,330	-
1.期貨-長部位(Futures - Long Positions)	53,209	0.33	-	-	53,209	-
2.期貨-短部位(Futures - Short Positions)	53,121	0.32	-	-	53,121	-
3.買入選擇權(Bought Options)	-	-	-	-	-	-
4.賣出選擇權(Sold Options)	-	-	-	-	-	-
三、權益證券有關契約(Equity-linked Contracts)	370,723	2.28	410,804	2.85	-40,081	-9.76
(一)店頭市場(OTC)	1,835	0.01	7,907	0.05	-6,072	-76.79
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	368,888	2.27	402,897	2.80	-34,009	-8.44
四、商品有關契約(Commodity Contracts)	43,996	0.27	16,266	0.11	27,730	170.48
(一)店頭市場(OTC)	20,005	0.12	7,465	0.05	12,540	167.98
(二)交易所(Exchange-traded Contracts)	23,991	0.15	8,801	0.06	15,190	172.59
小 計(一至四)	16,287,782	99.99	14,406,461	99.99	1,881,321	13.06
五、信用有關契約(Credit Contracts)	1,822	0.01	1,716	0.01	106	6.18
1.信用違約交換(Credit Default Swap)	1,822	0.01	1,716	0.01	106	6.18
2.買入信用違約選擇權(Bought Credit Default Options)	-	-	-	-	-	-
3.賣出信用違約選擇權(Sold Credit Default Options)	-	-	-	-	-	-
4.其他(Other)	-	-	-	-	-	-
六、其他有關契約(Other Contracts)	-	-	-	-	-	-
1.遠期契約(Outright Forwards)	-	-	-	-	-	-
2.交換(Swaps)	-	-	-	-	-	-
3.選擇權(Options)	-	-	-	-	-	-
總 計 ^註	16,289,604	100.00	14,408,177	100.00	1,881,427	13.06

註：包括國內總分支機構及國際金融業務分行資料，不含海外分行及子行；本表已剔除銀行間交易重複計算部分。

附圖1 銀行辦理衍生性金融商品交易量趨勢統計



附圖2 104年7月銀行衍生性金融商品交易量內容分析
幣別



銀行類別

